

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 07 de marzo de 2024
Fecha de Información: 05 de marzo de 2024¹

Según el reporte de los Sistemas de Información y Registro de Operaciones sobre Divisas del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$3540 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.18%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados³

Rango	Sector Financiero ²		Intragrupa y Off-shore ³		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	746,4	638,7	229,7	335,5	3,5	5,3	405,6
15-35	924,5	956,5	505,8	476,8	31,8	28,7	419,0
36-60	357,3	294,8	56,0	76,7	5,6	47,5	233,2
61-90	58,3	39,5	35,0	2,0	4,5	56,3	0,0
91-180	218,6	317,0	117,2	20,0	19,9	18,6	180,0
>180	35,7	220,4	185,8	5,0	4,6	0,7	30,0
Total	2340,8	2467,0	1129,4	916,0	69,9	157,1	1267,8

Cuadro No. 2 Devaluación Implícita Ponderada por monto Anualizada

Rango	Intermediarios del Mercado Cambiario ¹	Otros Agentes sin intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	6.63%	6.08%	6.48%	6.46%
15-35	6.59%	5.66%	5.23%	5.90%
36-60	6.54%	6.99%	6.44%	6.53%
61-90	–	6.47%	6.03%	6.21%
91-180	6.24%	6.29%	5.62%	6.18%
>180	5.79%	5.67%	5.42%	5.71%
Total	6.52%	5.88%	5.90%	6.18%

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

¹A partir del 7 de diciembre se calcula este reporte incorporando la información preliminar reportada por los Sistemas de Información y Registro de Operaciones sobre divisas al Banco de la República.

²El monto negociado diario corresponde a las operaciones de compra y venta evitando la doble contabilización de las operaciones interbancarias. Además, la fórmula para la devaluación implícita es: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (365/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

³Cifras en millones de dólares

²Incluye operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario y operaciones con los otros agentes

³Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior

¹Incluye solo operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario

Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

Sectores	04 - 08 mar.				11 - 15 mar.				18 - 22 mar.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	40	104	6858	7105	70	135	5605	6366	36	211	10727	11624
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3349	2897	0	0	3505	2448	0	0	6542	5086
Otros ^c	104	40	518	720	135	70	445	715	211	36	629	1176
Total	144	144	10725	10722	205	205	9555	9529	247	247	17898	17886

^a Cifras en millones de dólares.

^b Incluye operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario y otros agentes

^c Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.